

# 华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

华富中小板指数增强型证券投资基金由华富基金管理有限公司依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1352号文核准，核准日期为2011年8月25日，本基金基金合同于2011年12月9日正式生效。

本基金管理人保证本招募说明书内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资人应当认真阅读本基金的《基金合同》、本招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

本基金不同于具有稳定收益和低风险的银行存款和国债，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%，属于较高风险、较高收益的投资品种。适合有稳定收入来源、风险承受能力相对较强、并希望分享中国证券市场长期发展成果的投资者。中国资本市场未来发展前景广阔，但股市投资始终伴随风险，股价波动更是无法避免，本基金至少85%的资产投资于股票市场，基金份额净值必然会随股市行情变化上下波动，持有人购买的基金份额净值因此存在下跌甚至亏损的可能性。对希望通过短期资金、借贷资金以及养老资金进行投机快速获得高额收益的投资者可能面临较大的风险。

华富基金承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩和华富基金旗下其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。华富基金提醒投资人基金投资的买者自负原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括管理风险、技术风险以及其它风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金的《基金合同》和《招募说明书》已通过指定报刊和华富基金的互联网网站 [www.hffund.com](http://www.hffund.com) 进行

了公开披露。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金《招募说明书》以及相关公告。

选择优秀的基金产品长期持有，是基金持有人规避市场短期波动风险、获取投资收益的有效方法。华富基金鼓励投资者避免短期频繁操作，坚持长期投资。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2017年12月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：华富基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

邮政编码：200120

法定代表人：章宏韬

设立日期：2004年4月19日

核准设立机关：中国证监会

核准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】47号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

联系人：邵恒

电话：021-68886996

传真：021-68887997

股权结构：华安证券股份有限公司49%、安徽省信用担保集团有限公司27%、合肥兴泰金融控股（集团）有限公司24%

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

章宏韬先生，董事长，大学本科学历，工商管理硕士，经济师。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科级秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理，华安证券有限责任公司办公室副主任、总裁助理兼办公室主任、副总裁。现任华安证券股份有限公司董事、总经理，兼任华富基金管理有限公司董事长，华安期货有限责任公司董事，中国证券业协会创新发展战略专业委员会委员。

姚怀然先生，董事，学士学位、研究生学历，经济师。历任中国人民银行安徽省分行金融管理处主任科员，安徽省证券公司营业部经理、总办主任、总经理助理兼证券投资总部总经理，华安证券有限责任公司总裁助理兼证券投资总部总经理，华富基金管理有限公司董事长、总经理，上海华富利得资产管理有限公司董事长。现任上海华富利得资产管理有限公司董事。

范强先生，董事，大专学历，历任安徽省财政厅工交处副主任科员、主任科员、副处长，安徽省财政厅工交处副处长，省地税局直属分局副局长、局长，省地税局计财处处长，省地税局财监处处长，安徽省信用担保集团副总经理兼任华安证券董事、皖煤投资有限公司董事长，现任安徽省信用担保集团副总经理、党委委员。

郑晓静女士，董事，硕士研究生学历。历任合肥市财政局预外局（非税局）科员，合肥市财政局办公室科

员、副主任，合肥市财政局预算处副处长，合肥市金融办（市投融资管理中心）资本市场处（企业融资处）副处长（主持工作），合肥市金融办担保与保险处处长，合肥市金融办资本市场处处长。现任合肥兴泰金融控股（集团）有限公司副总裁，兼任合肥兴泰资本管理有限公司董事长。

余海春先生，总经理，硕士研究生学历。曾先后担任安徽省证券公司合肥营业部业务员、上海自忠路营业部业务主管、合肥第二营业部经理助理，华安证券股份有限公司投资总部副总经理、池州营业部总经理、合肥花园街营业部总经理、办公室主任、固定收益部总经理、投资管理部总经理，现任华富基金管理有限公司总经理。

刘瑞中先生，独立董事，研究生学历。历任安徽铜陵财专教师，中国经济体制改革研究所助理研究员、信息部主任，中国国际期货经纪有限公司任信息部经理、深圳公司副总经理，北京商品交易所常务副总裁，深圳特区证券公司（现巨田证券）高级顾问。现任深圳神华期货经纪有限公司独立董事，冠通期货经纪有限公司独立董事。

陈庆平先生，独立董事，工商管理硕士。历任上海金融专科学校讲师、处长，申银证券公司哈尔滨营业部总经理，上海鑫兆投资管理咨询有限公司顾问，宁波国际银行上海分行行长，上海金融学院客座教授。

张赛美女士，独立董事，硕士学位，研究生学历。历任上海张江公社团委副书记，上海建平中学教师，上海社会科学院经济研究所助理研究员，海通证券股份有限公司投资银行部副总经理（主持工作）、投资银行管理部总经理、并购及资本市场部总经理、战略规划部总经理、衍生产品部总经理，海通开元投资有限公司董事长，海通创意资本管理有限公司董事长。现任上海双创投资管理有限公司创始合伙人，上海双创投资中心总经理。

## 2、基金管理人监事会成员

王忠道先生，监事会主席，本科学历。历任上海财经大学金融理论教研室助教，安徽省财政厅副主任科员，安徽信托投资公司部门经理、安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省皖煤投资有限公司总经理。现任安徽省信用担保集团有限责任公司总经济师。

梅鹏军先生，监事，金融学博士，高级经济师。先后在安徽省国际经济技术合作公司，安徽省物资局（后更名为安徽省徽商集团）工作，历任合肥兴泰控股集团有限公司投资发展部业务经理，合肥兴泰控股集团有限公司金融研究所副所长。现任合肥兴泰金融控股（集团）有限公司金融研究所所长，安徽大学经济学院金融硕士研究生兼职导师。

李宏升先生，监事，本科学历，经济师。历任国元证券斜土路营业部交易部经理，交通银行托管部基金会计、基金清算。现任华富基金管理有限公司综合管理部总监。

邵恒先生，监事，工商管理硕士，研究生学历，CFA。历任雀巢（中国）有限公司市场部助理、强生（中国）有限公司市场部助理、讯驰投资咨询公司高级研究员、华富基金管理有限公司整合营销经理、双子座信息公司合伙人。现任华富基金管理有限公司总经理助理兼市场拓展部总监。

## 3、高级管理人员

章宏韬先生，董事长，简历同上。

余海春先生，总经理，简历同上。

满志弘女士，督察长，管理学硕士，CPA。曾任道勤控股股份有限公司财务部总经理，华富基金管理有限公司监察稽核部副总监兼董事会秘书，上海华富利得资产管理有限公司监事，现任华富基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

陈大毅先生，副总经理，硕士学位。曾先后供职于安徽省证券公司上海自忠路营业部、徐家汇路营业部，华安证券上海总部，华安证券网络经纪公司（筹）。曾任华富基金管理有限公司总经理助理兼运作保障部总监，上海华富利得资产管理有限公司总经理。现任华富基金管理有限公司副总经理，上海华富利得资产管理有限公司董事长。

龚炜先生，副总经理，硕士学位，先后供职于湘财证券有限责任公司、中国证监会安徽监管局、天治基金管理有限公司。曾任华富基金管理有限公司金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理。现任华富基金管理有限公司副总经理、公司公募投资决策委员会主席、基金经理。

曹华玮先生，副总经理，硕士学位，先后供职于庆泰信托公司、新疆金新信托投资股份有限公司、德恒证券有限责任公司、嘉实基金管理有限公司、汇添富基金管理有限公司、华泰柏瑞基金管理有限公司。曾任华富基金管理有限公司总经理助理、机构理财部总监，现任华富基金管理有限公司副总经理。

#### 4、本基金基金经理简介

高靖瑜女士，复旦大学金融学硕士，本科学历。十七年证券从业经验，历任金鼎综合证券（维京）股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员，2007年7月加入华富基金管理有限公司，先后担任研究部行业研究员、华富价值增长灵活配置混合型基金基金经理助理、2014年12月15日至2016年1月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理。现任华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文娱灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理。

本基金历任基金经理：

郭晨先生，2011年12月9日至2012年12月19日担任华富中小板指数增强型基金基金经理。

朱蓓女士，2012年12月19日至2017年9月22日担任华富中小板指数增强型基金基金经理。

#### 5、公募投资决策委员会成员

公募投资决策委员会是负责公募基金投资决策的最高权力机构，由公司分管公募投资业务的领导、涉及公募投资和研究的部门的业务负责人以及公募投资决策委员会认可的其他人员组成。公募投资决策委员会主席由公司分管公募投资业务的最高业务领导担任，负责投决会的召集和主持。

公募投资决策委员会成员姓名和职务如下：

龚炜先生 T 公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理、基金经理

胡伟先生 公司公募投资决策委员会成员、公司总经理助理，固定收益部总监、基金经理

邴彬先生 公司公募投资决策委员会成员、研究发展部总监

陈启明先生

尹培俊先生

公司公募投资决策委员会成员、基金投资部总监、基金经理

公司公募投资决策委员会成员、固定收益部总监助理、基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016中国最佳银行，《环球金融》2016中国最佳消费者银行、2016亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016年世界银行1000强排名中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构：

名称：华富基金管理有限公司直销中心和网上交易系统

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层

法定代表人：章宏韬

联系人：李晔

咨询电话：021-50619688，400-700-8001

传真：021-68415680

网址：[www.hffund.com](http://www.hffund.com)

##### 2、代销机构：

###### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

联系人：王琳

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### （2）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-95559

传真：021-62701216

联系人：张宏革

客户电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

###### （3）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83161095

传真:0755-83195050

联系人:于菲

客服电话: 95555

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(4) 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号

法定代表人: 常振明

电话: 010-89937369

传真: 010-85230049

联系人: 廉赵峰

客户服务热线: 95558

公司网站: <http://bank.ecitic.com>

(5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市中山东一路 12 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 高国富

电话: (021)61618888

传真: (021)63604199

联系人: 于慧、虞谷云

客户服务热线: 95528

公司网址: [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(6) 平安银行股份有限公司

法定代表人: 谢永林

注册地址: 深圳市深南东路 5047 号

办公地址: 深圳市深南东路 5047 号

联系人: 张波

联系电话: 0755-22168073

客户服务电话: 95511-3

公司网址:[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(7) 北京银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人: 闫冰竹

联系人: 谢小华

传真: 010-66226045

客服电话: 95526

公司网址: [www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(8) 渤海银行股份有限公司

住所: 天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人: 李伏安

电话: 022-58316666

传真: 022-58316569

联系人: 王宏

客服电话: 95541



公司网址: [www.cbhb.com.cn](http://www.cbhb.com.cn)

(9) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦

法定代表人: 李伟

联系人: 陈聪

电话: 0755-25188263

传真: 0755-25188785

网站: [www.4001961200.net](http://www.4001961200.net)

客户服务电话: 400-196-1200

(10) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

办公地址: 上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20 楼、22-27 楼

法定代表人: 冀光恒

联系人: 李晨

电话: 021-38576666

客服电话: 021-962999, 400-696-2999

网址: [www.srcb.com](http://www.srcb.com)

(11) 华夏银行股份有限公司

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人: 吴建

联系人: 刘军翔

联系电话: 010-85238820

客服电话: 95577

网址: [www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(12) 中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 洪崎

客服电话: 95568

传真: (010) 57092611

联系电话: (010) 57092615

联系人: 董云巍

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(13) 中国农业银行股份有限公司

法定代表人: 蒋超良

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

联系人: 牛峰

电话: 010-85108223

传真: 010-85109219

客服电话: 95599

网址: [www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(14) 徽商银行股份有限公司

住所: 合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址: 合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

联系电话：0551-62667635

传真电话：0551-62667684

客户服务电话：40088-96588（安徽省内可直拨 96588）

公司网址：[www.hsbank.com.cn](http://www.hsbank.com.cn)

（15）恒丰银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号

办公地址：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号

法定代表人：蔡国华

联系人：汪岛

电话：021-38966235

传真：021-38966204

客户服务电话：95395

公司网站：[www.egbank.com.cn](http://www.egbank.com.cn)

（16）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：95318

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

（17）爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 33 楼

法定代表人：钱华

联系人：王冠昌

联系电话：021-32229888

业务传真：021-68728703

客服热线：4001-962502

公司网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

（18）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：95321

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（19）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静



电话：010-84183333

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(20) 东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

客服电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

(21) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87107535

传真：027-87618863

客户服务电话：4008005000

公司网站：www.tfzq.com

(22) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315290

传真：021-20315137

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(23) 民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：余政

联系人：赵明

电话：010-85127622

传真：010-85127917

客服电话：4006198888

公司网址：www.msyzq.com

(24) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 8 楼

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：沈刚

客服电话：95570

网址：[www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

（25）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525、4008888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（26）中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：张鹏

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008、95532

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（27）万联证券有限责任公司

住所：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：甘蕾

电话：020-38286026

传真：020-38286588

客服电话：4008888133

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

（28）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 20 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

客服电话：95562

公司网站：[www.xyq.com.cn](http://www.xyq.com.cn)

（29）山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-161895573

公司网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(30) 日信证券有限责任公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人: 孔佑杰

联系人: 陈文彬

电话: 010-83991716

传真: 010-66412537

客户服务电话: 400-660-9839

公司网站: [www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

(31) 江海证券有限公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

联系人: 周俊

电话: 0451-85863726

传真: 0451-82287279

客服电话: 400-666-2288

公司网址: [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(32) 长城证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14/16/17 层

法定代表人: 黄耀华

联系人: 李春芳

电话: 0755-83516289

传真: 0755-83516189

客服电话: 400-666-6888、0755-33680000

公司网站: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(33) 大通证券股份有限公司

住所: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层

法定代表人: 张智河

联系人: 谢立军

电话: 0411-39673202

客服电话: 4008-169-169

网址: [www.daton.com.cn](http://www.daton.com.cn)

(34) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

联系人: 芮敏祺

电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

客服电话: 95521

公司网址: [www.gtja.com.cn](http://www.gtja.com.cn)

(35) 恒泰证券股份有限公司

住所: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

电话：0471-4972343

传真：0471-4961259

客服电话：0471-4972343

公司网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(36) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：周杨

客服电话：95536

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(37) 招商证券股份有限公司

注册(办公)地址:深圳市益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人:宫少林

联系人:黄婵君

电话:0755-82943666

传真:0755-83734343

客户服务电话:400-8888-111,95565

网址:[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(38) 长城国瑞证券有限公司

注册地址：福建省厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：福建省厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼

法定代表人：王勇

电话：0592-2079303

传真：0592-2079602

联系人：赵钦

客户服务热线：400-0099-886

公司网址：[www.gwgsc.com](http://www.gwgsc.com)

(39) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

客服电话：400-888-8108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(40) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(41) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(42) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(43) 新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：宋旻

电话：010-83561070

客户服务电话：400-698-9898

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

(44) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

电话：010-66568292

传真：010-66568990

客服电话：400-888-8888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(45) 华龙证券股份有限公司

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法定代表人：李晓安

联系人：范坤

电话：0931-4890208

客服电话：95368

公司网址: [www.hlzq.com](http://www.hlzq.com)

(46) 南京证券股份有限公司

住所: 江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人: 张华东

联系人: 徐翔

电话: 025-83364032

传真: 025-83320066

客户服务电话: 400-828-5888

网址: [www.njq.com.cn](http://www.njq.com.cn)

(47) 华福证券有限责任公司

住所: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人: 黄金琳

联系人: 郭相兴

联系电话: 021-20655175

客户服务电话: 96326 (福建省外请先拨 0591)

公司网址: [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(48) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 王连志

联系人: 陈剑虹

电话: 0755-82825551

客服电话: 400-800-1001

公司网址: [www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(49) 中山证券有限责任公司

住所: 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦 7 层、8 层

法定代表人: 黄扬录

联系人: 罗艺琳

电话: 0755-82570586

客服电话: 95329

公司网址: [www.zszq.com](http://www.zszq.com)

(50) 平安证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 詹露阳

联系人: 周一涵

电话: 021-38637436

客服电话: 95511-8

公司网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(51) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

联系电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客服电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（52）湘财证券有限责任公司

住所：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：陈学荣

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

客户服务热线：400-888-1551

公司网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

（53）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客服电话：400-860-1555

公司网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

（54）华宝证券有限责任公司

住所：上海世纪大道 100 号环球金融中心 57 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

联系人：汪明丽

电话：021-68778075

客服电话：400-820-9898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

（55）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：顾凌

电话：010-60838888

传真：010-60833739

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（56）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客服电话：0755-83199511



公司网址: [www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

(57) 长江证券股份有限公司

注册地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 尤习贵

客户服务热线: 95579 或 4008-888-999

联系人: 奚博宇

电话: 027-65799999

传真: 027-85481900

公司网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(58) 中信证券(山东)有限责任公司

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人: 杨宝林

联系人: 吴忠超

联系电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

客服电话: 95548

公司网址: [www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

(59) 国海证券股份有限公司

住所: 广西桂林市辅星路 13 号

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅锋

联系人: 牛孟宇

电话: 0755-83709350

客服电话: 95563

公司网址: [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(60) 中信证券(浙江)有限责任公司

住所: 浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22、23 层

法定代表人: 沈强

联系人: 李珊

联系电话: 0571-85776114

客服电话: 95548

公司网址: [www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

(61) 西南证券股份有限公司

住所: 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人: 吴坚

联系人: 张煜

电话: 023-63786633

客服电话: 4008096096

公司网址: [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(62) 国盛证券有限责任公司

注册地址: 南昌市北京西路 88 号(江信国际金融大厦)

法定代表人: 徐丽峰

联系人: 周欣玲

联系电话: 0791-86281305

传真：0791-86281305

客服电话：4008222111

公司网址：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

(63) 国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服电话：95310

公司网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(64) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：0571-26888888-37494

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(65) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(66) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(67) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)，[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(68) 和讯信息科技有限公司

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

电话：021-20835789

传真：021-20835885

客服电话：400-920-0022

公司网址：[licaikexun.com](http://licaikexun.com)

(69) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

联系人：韩曼玲

电话：021-20691832

传真：02120691861

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(70) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 楼

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(71) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

电话：021-50583533

传真：021-50583633

客服电话：400-921-7755

公司网址：[a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn)

(72) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

客服电话：400-876-9988

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

公司网站：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(73) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 层

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

电话：021-80359115

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(74) 中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

法定代表人：姜新

联系人：侯英建

电话：010-65807865

传真：010-65807864

客服电话：95162-2

公司网址：www.cifcofund.com

(75) 北京增财基金销售有限公司

住所：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

电话：010-67000988-6025

传真：010-67000988-6000

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(76) 北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 10 层 1007-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：陈剑炜

电话：010-57418813

传真：010-57569671

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

(77) 一路财富（北京）信息科技有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：刘栋栋

电话：010-88312877-8009

传真：010-88312099

客服电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(78) 中国国际期货有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层

法定代表人：王兵

联系电话：010-59539864

传真：010-59539806

联系人：赵森

客户服务电话：95162、400-8888-160

网址：www.cifco.net

(79) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人：沈伟桦

联系人：王巨明

电话：010-52855713

传真：010-85894285

客服电话：400-6099-200

公司网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(80) 上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户服务电话：4000-466-788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(81) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区 100 号 19 层

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：李栋

电话：021-33323999-8048

传真：021-33323830

客户服务电话：400-821-3999

网址：<https://tty.chinapnr.com/>

(82) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中心 3 号

法定代表人：林卓

联系人：戚文

电话：0411-88891212-119

传真：0411-84396536

客户服务电话：400-6411-999

网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(83) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：文雯

电话：010-83363101

传真：010-83363072

客户服务电话：400-166-1188

网址：<http://8.jrj.com.cn>

(84) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-60833754

传真：010-57762999

客服电话：4009908826

公司网站：www.citicsf.com

(85) 大泰金石基金销售有限公司

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：021-22267943

传真：021-20324199

客户服务电话：400-928-2266

网址：www.dtfortune.com

(86) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：鲍东华

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-50783597

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

(87) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客户服务电话：400-918-0808

网址：www.xds.com.cn

(88) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

电话：029-63387289

客户服务电话：400-860-8866

网址：www.kysec.cn

(89) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：021-51327185

传真：021-50710161

客户服务电话：400-821-0203

公司网站：www.520fund.com.cn

（90）浙江金观诚财富管理有限公司

住所：浙江省杭州市拱墅区登云路 43 号锦昌大厦一楼金观诚财富大厅

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

电话：0571-88337717

传真：0571-88337666

客服电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

（二）注册登记机构

名称：华富基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1000 号 31 层

法定代表人：章宏韬

联系人：潘伟

电话：021-68886996

传真：021-68887997

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：杭州市西溪路 128 号 9 楼

执行事务合伙人：胡少先

电话：021-62281910

传真：021-62286290

联系人：曹小勤

经办注册会计师：曹小勤、林晶

四、基金名称

华富中小板指数增强型证券投资基金

五、基金类型

契约型、开放式

六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，以被动跟踪标的指数为主，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础上，力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（其中包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规



或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 八、基金的投资策略

作为指数增强型基金，本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上，采用适度的主动投资辅助提高收益，降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法，按照标的指数的成份股组成及其权重构建指数化投资组合，并按照标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股，在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。

### （一）资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金，为实现有效跟踪标的指数并力争超越比较基准的投资目标，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金将根据市场情况及投资研究团队的研究成果，在基金合同规定的范围内对基金资产配置进行适当的主动调整，确定基金资产中股票、债券和现金的配置比例。

### （二）股票投资策略

本基金采用指数化被动投资为主、主动增强为辅的投资策略来构建股票投资组合，指数化投资部分运用被动投资策略，采用全复制的方法，对成份股及备选成份股进行配置。增强投资部分依托本公司投研团队的研究成果构建增强股票组合，争取获得超额收益。

#### 1. 指数化被动投资策略

被动投资部分本基金采用完全复制指数的投资策略，即按照标的指数成份股及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

##### （1）股票组合构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股及其权重对其逐步买入。本基金可以根据市场情况适时买入，以降低建仓成本。

##### （2）股票组合调整

本基金根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金还将根据基金份额申购赎回情况、法律法规中的投资比例限制等因素对股票组合进行适时调整。

#### 1) 定期调整

标的指数每年在固定时间对成份股及权重进行定期调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。

#### 2) 不定期调整

a.当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数编制单位在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

b.当标的指数成份股及权重因新股上市快速计入指数需进行调整时，本基金将根据标的指数编制单位发布的临时调整决定进行相应调整。

c.如果预期标的指数的成份股及权重将发生调整，本基金可对投资组合进行前瞻性调整。

d.本基金根据申购和赎回情况，结合现金头寸管理，调整投资股票资产配置比例。

##### （3）成份股替代股票的选择

如果因成份股停牌、流动性不足或法律法规中的投资比例限制等因素使得本基金无法购买标的指数某成份股或者无法按照标的指数某成份股的权重购买足够数量的该成份股时，本基金可以根据市场情况，买入该

成份股的替代股票，以维持该成份股在本基金股票资产中的配置比例。

## 2. 主动增强投资策略

作为指数增强型基金，本基金将在指数化被动投资的基础之上，适当进行部分主动投资，一方面弥补在指数化投资过程中，由于交易成本、管理费用等因素造成的与比较基准之间的差距，另一方面力争在一定的跟踪误差下，取得部分超额收益。本基金主要采用以下几种主动增强投资策略：

### （1）成份股及备选成份股的增强策略

本基金跟踪标的为中小板指数，中小板公司规模较小，成立时间较短，大多属于新兴行业，相比大盘蓝筹股，非系统性机会和非系统性风险都较大，因此对成份股和备选成份股进行适度增强十分必要。

本基金将依托公司投研平台、通过案头研究，实地调研，结合外部专业研究力量等方式，综合考查行业发展前景、公司成长性、估值、非系统性风险等因素，适当超配行业发展前景好、估值低、成长性好、投资风险小的成份股或备选成份股，低配基本面和估值存在瑕疵的成份股。

### （2）非成份股及备选成份股的增强策略

本基金将适当的投资于非成份股及备选成份股，来获取超额收益。依托于本基金管理人投研团队的深入研究，筛选出非成份股增强股票，择机进行配置。

### （3）一级市场股票投资增强策略

本基金可以适当参与一级市场股票的投资，包括新股申购、增发等方式，在严格控制额外风险的前提下提高基金的收益水平。

## （三）债券投资策略

本基金基于流动性管理、提高基金资产的使用效率、增强收益的需要，可以进行适当的债券投资。本基金依托基金管理人的固定收益团队，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

## （四）权证投资策略

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，充分利用来达到控制风险、实现保值和锁定收益等目的。

## （五）跟踪偏离的监控与管理

本基金为股票指数增强型基金，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，将年化跟踪误差控制在 7.75% 以内。本基金定期对跟踪误差和跟踪偏离度进行跟踪，如跟踪指标达到或接近控制标准，则金融工程研究团队会对跟踪偏差进行归因分析，找出造成跟踪偏差的来源，通过对投资组合进行适当的调整，以使跟踪指标回归到合理范围。

## 九、业绩比较基准

标的指数：中小企业板价格指数（证券代码：399005，简称为中小板指数）

业绩比较基准：中小板指数收益率\*90%+一年期银行定期存款利率(税后)\*10%

如果中小板指数被停止编制及发布，或中小板指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中小板指数不宜继续作为本基金的业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的业绩比较基准；并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒体上公告。

## 十、风险收益特征

本基金属于股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下，其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的

真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 8,607,089.27 85.62

其中：股票 8,607,089.27 85.62

2 基金投资 --

3 固定收益投资 425,148.00 4.23

其中：债券 425,148.00 4.23

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 800,000.00 7.96

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 197,127.43 1.96

8 其他资产 23,218.67 0.23

9 合计 10,052,583.37 100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 30,640.00 0.32

B 采矿业 --

C 制造业 5,621,493.74 58.74

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 217,758.62 2.28

F 批发和零售业 252,709.50 2.64

G 交通运输、仓储和邮政业 38,486.00 0.40

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 983,097.80 10.27

J 金融业 625,297.03 6.53

K 房地产业 120,780.52 1.26

L 租赁和商务服务业 217,706.46 2.27

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 60,647.60 0.63

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 95,256.00 1.00

R 文化、体育和娱乐业 104,080.00 1.09

S 综合 --

合计 8,367,953.27 87.43

## 2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	--	
B	采掘业	--	
C	制造业	239,136.00	2.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
E	建筑业	--	
F	批发和零售业	--	
G	交通运输、仓储和邮政业	--	
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	--	
J	金融业	--	
K	房地产业	--	
L	租赁和商务服务业	--	
M	科学研究和技术服务业	--	
N	水利、环境和公共设施管理业	--	
O	居民服务、修理和其他服务业	--	
P	教育	--	
Q	卫生和社会工作	--	
R	文化、体育和娱乐业	--	
S	综合	--	
合计		239,136.00	2.50

## 2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1	002415	海康威视	15,247	487,904.00	5.10
2	002304	洋河股份	2,658	269,787.00	2.82
3	002230	科大讯飞	4,837	259,505.05	2.71
4	002450	康得新	10,789	228,834.69	2.39
5	002024	苏宁云商	16,715	218,966.50	2.29
6	002466	天齐锂业	3,100	217,899.00	2.28
7	002460	赣锋锂业	2,440	213,012.00	2.23
8	002456	欧菲光	9,055	191,875.45	2.00
9	002241	歌尔股份	9,286	187,948.64	1.96
10	002594	比亚迪	2,725	186,117.50	1.94

#### 3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000597	东北制药	21,200	239,136.00	2.50

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	425,148.00	4.44
其中：政策性金融债		425,148.00	4.44
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债 (可交换债)	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	425,148.00	4.44

#### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	108601	国开 1703	4,260	425,148.00	4.44

#### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	879.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,811.68

5 应收申购款	16,527.94
6 其他应收款	-
7 待摊费用	-
8 其他	-
9 合计	23,218.67

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 — —

2011.12.09

-2011.12.31 1.00% 0.22% -9.04% 1.29% 10.04% -1.07%

2012.01.01

-2012.12.31 -8.71% 1.07% -0.68% 1.32% -8.03% -0.25%

2013.01.01

-2013.12.31 16.27% 1.39% 16.31% 1.38% -0.04% 0.01%

2014.01.01

-2014.12.31 15.49% 1.18% 9.18% 1.14% 6.31% 0.04%

2015.01.01

-2015.12.31 40.23% 2.76% 48.78% 2.45% -8.55% 0.31%

2016.01.01

-2016.12.31 -25.58% 1.61% -20.45% 1.61% -5.13% 0.00%

2017.01.01

-2017.09.30 9.83% 0.71% 15.23% 0.75% -5.40% -0.04%

2011.12.09

-2017.09.30 41.90% 1.61% 56.45% 1.55% -14.55% 0.06%

### （二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

### 十三、基金费用与税收

#### (一)基金费用的种类

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金财产划拨支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用
- 9.标的指数使用许可费；
- 10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### 3.标的指数使用许可费

指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付，收取标准和方法为：

$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$

H=每日应付的指数使用许可费；E=前一日基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取。

4.除管理费、托管费和标的指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### (四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费



以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对原《华富中小板指数增强型证券投资基金招募说明书更新

（2017 年第 1 号）》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1.在重要提示部分，更新招募说明书更新截止日期。
- 2.在三、基金管理人部分，更新了主要人员情况的相关信息。
- 3.在四、基金托管人部分，更新了主要人员情况的相关信息。
- 4.在五、相关服务机构中更新了相关服务机构的内容。
- 5.在十、基金投资中，更新了财务数据的截止日期，增加了基金最近一期投资组合报告的内容。
- 6.在十一、基金的业绩中，增加了基金最近一期的业绩说明。
- 7.在二十三、其他应披露事项披露了本期基金的相关公告。

华富基金管理有限公司

二零一八年一月